## **Berechnung CVA**



Auswertung per: 20.11.2025 23:45 Bewertungsdatum: 20.11.2025 23:45

Fonds: Währung: 2496T2 Capitulum Weltzins-Invest Universal AK I EUR

ISIN:

DE000A2H7NU1 529900Q626RC55DLB570 263.790.985,06 3.173.583 LEI:

Fondsvermögen: Anteile in Umlauf:

| Kontrahent ID   | Kontrahent   | Kontrahent-LEI   | KSA Bonitätsstufe<br>Kontrahent | Risikogewicht je<br>Kontrahent (RW) | Standard CVA-<br>Risiko SCVA | Term 1 Fonds<br>(Zwischenergebnis)  | Term 2 Fonds<br>(Zwischenergebnis)   | CVA-Risiko im<br>Rahmen des<br>Basisansatzes - B<br>unhedged BACVA                              | CVA-Risiko im<br>Rahmen des<br>asisansatzes - total<br>BACVA | total BACVA<br>in % FV | Zielfonds Anzahl<br>Gegenparteien |
|---|--|--|---------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------|--|---|--|------------------------|-----------------------------------|
| 871001  | BNP Paribas S.A.   | R0MUWSFPU8MPRO8K5P   | 2                               | 5,00                                | 13.274,00                    | 1.709.996.266,22                    | 3.747.563.638,84   | 48.018,94   | 48.018,94  | 0,02                   | 0                                 |
| 805250  | J.P. Morgan SE   | 549300ZK53CNGEEI6A29   | 1                               | 5,00                                | 69.430,20                    | 1.709.996.266,22                    | 3.747.563.638,84   | 48.018,94   | 48.018,94  | 0,02                   | 0                                 |
| Total   |  |  |                                 |                                     |                              |                                     |  | 48.018,94   | 48.018,94  | 0,02                   |                                   |
|   |  |  |                                 |                                     |                              |                                     |  | da  | avon OTC:<br>2.140.382,99                                    | 0,81                   | _                                 |
| Fondsvolumen inkl. Force<br>- Fondsvolumen aus Bev<br>Differenz |  |  |                                 |                                     |                              |                                     |  | 263.790.985,06<br>263.790.985,06<br>-0,00   |  |                        |                                   |
|   | CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten<br>Betrag Summe der Risikopositionswerte (OTC-Derivate mit CVA-Charge)<br>Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko der OTC-Derivate mit CVA-Relevanz<br>Betrag Nominalbetrag CVA-Geschäfte |  |                                 |                                     |                              | 0,02 Zeil<br>0,81 Zeil<br>0,18 Zeil | mular C25.01 Ide 20; Spalte 70 Ide 20; Spalte 10 Ide 20; Spalte 20 Ide 20; Spalte 30 Ide 20; Spalte 30 | 263.790.985,06 de<br><b>Betrag in Buchwert:</b> 48.017,87 2.140.384,23 465.343,13 23.459.053,65 | efault: Marktwert des F                                      | Fonds> mit Buc         | hwert überschreiben               |
|   | ZUSATZINFORMATIONEN: Gruppeninterne Geschäft: CVA-Risiko Betrag aus OTC-Derivaten Gruppeninterne Geschäft: Betrag Summe der Risikopositionswerte Gruppeninterne Geschäft: Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiausfallrisiko             |  |                                 |                                     |                              | 0,00 Zeil                           | le 40 u. 90; Spalte 70<br>le 40 u. 90; Spalte 10<br>le 40 u. 90; Spalte 20                             | -   |  |                        |                                   |
|   |  | Betrag Summe der Risiko<br>Betrag Eigenmittelanforderung aus dem Gegenparteiau | positionswerte (Wertpap         |                                     | fte mit CVA-Charge)          | 0,00 Zeil                           | le 130; Spalte 70<br>le 130 Spalte 10<br>le 130; Soalte 20   | -   |  |                        |                                   |